Rosario, 10 de Octubre de 2023

ACTIVOS ACEPTADOS EN CONCEPTO DE GARANTIA

El siguiente es un listado de los activos aceptados con sus correspondientes aforos en caso de corresponder. Argentina Clearing y Registro se reserva el derecho de modificar los activos aceptados o los aforos aplicados, los que deberán ser reemplazados o cubiertos de inmediato. Adicionalmente, Argentina Clearing y Registro se reserva el derecho de rechazar cualquiera de estos activos basado en, pero no limitado a: límites de concentración de carteras, precios de activos, volatilidad o liquidez de mercados secundarios donde se negocian estos activos. Argentina Clearing y Registro puede permitir el exceso a los límites máximos aceptados por ALYC, así como aceptar activos no integrantes del siguiente listado.

1. ACTIVOS ELEGIBLES

ACTIVOS EN EFECTIVO

PESOS EN CUENTAS A LA VISTA

- Depósito de pesos en cuentas a la vista de bancos locales.
- Depósitos de pesos en BCRA.

DÓLARES EN CUENTAS A LA VISTA

- Depósito de dólares en cuentas a la vista de bancos locales.
- Depósito de dólares en BCRA.
- Depósito de dólares en Caja de Valores.
- Depósito de dólares en cuentas a la vista de bancos extranjeros.
  - Bank of America, N.A. Member of Bank of America Corporation.

DÓLAR MtR

1- *El mecanismo Dollar-Linked es provisto por el BCRA, que emitió una letra (LEGAR – BCRA Com. "A" 7220) para garantizar la cobertura cambiaria. Las LEGAR poseen los riesgos propios de cualquier otro instrumento equivalente emitido por el BCRA. Este mecanismo está habilitado exclusivamente para mercados autorizados por CNV para brindar una opción de integración equivalente al dólar, pero su integración y rescate siempre se efectuará en pesos al tipo de cambio del día.*
2- *Cada ALyC podrá constituir garantías mediante el mecanismo Dollar-Linked establecido en el Instructivo de Liquidación por hasta 150% de los márgenes requeridos por la posición abierta de contratos de futuros y opciones sobre commodities cotizados en dólares y operatoria garantizada PAF en la medida que tenga un saldo deudor de márgenes que integrar. El aporte a la Garantía inicial (FGIMC) podrá ser constituido en Dólar MtR en la medida que el requerimiento surja por operatoria de productos que liquiden en Dólar MtR.*
3- *En caso de excesos y/o restricciones cambiarias del BCRA en la constitución de garantías mediante este mecanismo, Argentina Clearing y Registro y/o MATBA ROFEX podrán proceder a ordenar la conversión a pesos.*
4- *El reeemplazo de activos por este instrumento, deberá tener autorización previa de Argentina Clearing y Registro y/o MATBA ROFEX.*
5- *Asimismo se recuerda que dicho mecanismo Dollar-Linked puede ser también utilizado para la cobertura de las pérdidas brutas (diferencias más resultados) de las cuentas de registro en (t-1) por contratos de futuros y opciones sobre commodities cotizados en dólares.*

INSTRUMENTOS LOCALES

TITULOS VALORES

TÍTULOS SEGÚN EL EMISOR		ESPECIES							AFORO
Títulos emitidos por el Tesoro Nacional (1)		LETES	LECER	LELINKS	LEBADS	LEDES	LECAPS		80% sobre el valor de cotización
Títulos Públicos (1)		T7X4	TDG24	GD38	TDA24	TDS23	T7X4	T3V3	
		TX26	T5X4	T2X5	AE38	GD30	T4X4	TDF24	
			AL30	TV24	TX24	T2X4	TDG24	T3X4	
		AL41	TVPA	GD41	TVPY	CO26	BA37D		70% sobre el valor de cotización
		GD29	AL29	T5X4	TC23	TB24	PBY25		
		PR13	GD35	DICP	T2V4	TC25P	TVPP		
		TO26	GD46	AL35	T6X4	TX28	TO23		
			PARP	PBA25	CUAP	CO24D	TB23	BDC24	60% sobre el valor de cotización
		BDC28	PBJ27	BPLD	PBM24	CO23	PBY24		
Títulos Privados (1)	**Acciones**	ALUA	YPFD	TGSU2	BMA	GGAL	PAMP	TXAR	70% sobre el valor de cotización
		CEPU							
		AGRO	FIPL	BOLT	MOLA	DGCU2	TRAN	IRSA	60% sobre el valor de cotización
		CECO2	LONG	CGPA2	BPAT	HAVA	CAPX	PGR	
		FERR	RICH	GARO	CTIO	MORI	EDN	TGNO4	
		LOMA	BHIP	METR	GRIM	TGLT	IRCP	LEDE	
		QQQ	CELU	SAMI	CADO	DYCA	PATA	POLL	
		AUSO	BBAR	COME	GCLA	MIRG	SEMI	MTR	
		SUPV	BRIO	HARG	INVJ	OEST	VALO		
		CVH	MOLI	TECO2	BYMA	CARC	CRES		
		MAV (2)							50% sobre el valor de cotización
	CEDEARS	Todos los Cedears.							Entre el 60 y 70% sobre el valor de la cotización
	Corporativos (por emisor) (3)	YPF S.A. COMPAÑÍA GENERAL DE COMBUSTIBLES CRESUD S.A. EDENOR S.A. GENNEIA S.A. IRSA S.A. CAPEX S.A. ALUAR S.A. LOMA NEGRA PAMPA ENERGÍA S.A. GENERACION MEDITERRÁNEA S.A. CENTRAL TÉRMICA ROCA S.A. PAN AMERICAN ENERGY VISTA ENERGY ARGENTINA S.A.U. MSU S.A. BANCO MACRO BANCO HIPOTECARIO TECPETROL TELECOM								60% sobre el valor de la cotización

		AES ARGENTINA GENERACION MASTELLONE S.A. CLISA COMPAÑÍA LATINOAMERICANA CELULOSA ARGENITNA S.A. SAN MIGUEL ARCOR S.A.I.C. RAGHSA S.A. TARJETA NARANJA S.A.U. JOHN DEERE COMPAÑÍA FINANCIERA AEROPUERTOS ARGENTINA 2000 S.A. FUTUROS Y OPCIONES.COM S.A. PETROQUÍMICA COMODORO RIVADAVIA BARRAGAN SA	40% sobre el valor de la cotización

(1) Argentina Clearing y Registro podrá pedir la reducción de la tenencia de alguno de los activos integrados.
(2) En todos los casos la aceptación de acción estará sujeta a consulta previa a Argentina Clearing y Registro.
(3) Las Ons corporativas que no se encuentren listadas podrán ser aceptados previa consulta a Argentina Clearing y Registro.

FONDOS COMUNES DE INVERSIÓN

	Límite por ALYC	**Aforo para FCI de AAPIC con WS**	**Monto Mínimo Suscripción**	**Sociedades Gerentes Aceptadas**
MERCADO FONDOS COMUNES DE INVERSIÓN MTR (ORDENES HASTA LAS 15:00 HS/16:30 HS)	15% del patrimonio del Fondo o $250.000.000, de ambos el mayor	Renta Variable 75% Renta Mixta 85% Renta Fija 95% Plazo Fijo 100% De Dinero 100%	Definido por cada Sociedad Gerente (2)	• AdCap Asset Management S.A. • BACS Administradora de Activos S.A.S.G.F.C.I. • Balanz S.G.F.C.I.S.A. • Bull Market Asset Management • Capital Markets Argentina S.G.F.C.I.S.A. • CMF Asset Management S.A.U. • Consultatio Asset Management GFCI. • Delta Asset Management S.A. • First Capital Markets S.A • Gainvest S.A.S.G.F.C.I. • Galicia Administradora de Fondos S.A.S.G.F.C.I. • Galileo Argentina S.G.F.C.I.S.A. • IEB Fondos S.A. • Industrial Asset Management S.G.F.C.I.S.A • Investis Asset Management S.A.S.G.F.C.I. • Mariva Asset Management S.A.S.G.F.C.I. • Max Capital Asset Management S.A. • Megainver S.G.F.C.I. S.A. • Novus Asset Management • QM Asset Management S.G.F.C.I.S.A. • Quirón Asset Management S.A • Southern Trust S.G.F.C.I.S.A. • Tavelli y Cia. S.A • Ualintec Inversiones S.A. • Valiant Asset Management S.G.F.C.I.S.A.U • Zofingen investment S.A.

Se podrán enviar órdenes de suscripción/rescate desde las 10 hs hasta las 15 hs o 16:30 hs (según el FCI se encuentre o no en rueda extendida). Para conocer más acerca de los horarios, ventajas y fondos habilitados en rueda extendida, ingresar al siguiente link https://mercadofci.com.ar/.
No se podrá constituir FCI para garantizar operaciones de la cartera propia del Fondo o empresa del mismo grupo económico. Solo podrán garantizar operaciones de terceros.

	Límite por ALYC	Aforo para FCI de AAPIC sin WS	Aforo para FCI de AAPIC con WS	Monto Mínimo Suscripción	Sociedades Gerentes Aceptadas
CANAL TRADICIONAL FONDOS COMUNES DE INVERSIÓN (ORDENES HASTA LAS 13:00 HS)	15% del patrimonio del Fondo o $250.000.000 , de ambos el mayor	Renta Variable 70% Renta Mixta 80% Renta Fija 90% Plazo Fijo 100% De Dinero 100%	Renta Variable 75% Renta Mixta 85% Renta Fija 95% Plazo Fijo 100% De Dinero 100%	Definido por cada Sociedad Gerente (2)	• Allaria Ledesma Fondos Administrados S.G.F.C.I. SA (1) • Argenfunds S.A (1) • BNP Paribas Asset Management Arg S.A.S.G.F.C.I. • Deal Asset Management S.A • HSBC Administradora de Inversiones S.A.S.G.F.C.I. • ICBC Investments Argentina S.A.S.G.F.C.I. • Itaú Asset Management S.A.S.G.F.C.I • Macro Fondos S.G.F.C.I.S.A • Moneda S.G.F.C.I.S.A • Santander Rio Asset Management G.F.C.I.S.A. • Schroder S.A.S.G.F.C.I. • SBS Asset Management S.A. S.G.F.C.I. (1)

No se podrá constituir FCI para garantizar operaciones de la cartera propia del Fondo o empresa del mismo grupo económico. Solo podrán garantizar operaciones de terceros.

(1) Aforo diferencial en función de la información que suministra diariamente cada AAPIC a MATBA ROFEX y ACYRSA vía webservice (ws).

Se podrán suscribir por el canal tradicional, también los FCI de las sociedades gerentes incluidas en el Mercado de Fondos Comunes de Inversión MTR.

PLAZOS FIJOS

	Monto Mínimo por PF	Monto Máximo por PF	Aforo	Límite por ALYC	Plazo máximo	Generales
CERTIFICADOS DE DEPÓSITOS DE PLAZO FIJO (1) (2) (3)	$1.000.000	$20.000.000	90% sobre el capital + intereses	Hasta $60.000.000	30 días	Suscriptos a nombre de MATBA ROFEX y por cuenta del ALyC. No se permite la utilización de PF para garantizar el FGOMC y el FGIMC de aquellos ALYC que sean Entidades Financieras como así tampoco para garantizar la cartera de empresas del mismo grupo económico del Emisor.

(1) En todos los casos la aceptación de PF estará sujeta a consulta previa a Argentina Clearing y Registro y sujeto a la tasa y disponibilidad del Banco.

(2) Debido a que los Plazos Fijos son realizados a nombre de MATBA ROFEX, las retenciones de ganancias son efectuadas al Mercado, no pudiendo ser tomadas por los participantes.

AVALES

AVALES (1)	Características
	100% márgenes
Avales Locales (en pesos o dólares)	Hasta USD 1.000.000 (2)

(1) En todos los casos la aceptación del Aval estará sujeta a consulta previa a Argentina Clearing y Registro.

(2) Limite por CUIT/CUIL

CONDICIONES GENERALES

- El aval podrá otorgarse por un período de hasta un año con cláusulas y condiciones aceptados por ACYRSA.
- No podrá cubrirse con Avales el aporte al FGIALYC.
- No se permitirá la utilización de avales para garantizar la cartera propia del Emisor o empresas del mismo grupo económico.
- Dadas dos entidades financieras emisores de avales, las mismas, (o empresas de su mismo grupo económico) no podrán integrar simultáneamente garantías con avales emitidos por el otro. Al denotar dichos entidades financieras por A y B, la entidad A (o empresas de su mismo grupo económico) no puede integrar garantías con avales emitidos por la entidad financiera B y, al mismo tiempo, la entidad financiera B (o empresas de su mismo grupo económico) no puede integrar garantías con avales emitidos por banco A.

WARRANTS

	Características Generales	Bienes Aceptados	Aforo	Warranteras Habilitadas
Warrants (1)	Solo puede utilizarse para cubrir el requerimiento de los márgenes generados por PAF	Trigo Girasol Aceite de Girasol	100% del valor del instrumento	Control Unión Almacenadora Sudamericana

(1) En todos los casos la aceptación del Warrant estará sujeta a consulta previa a ACYRSA.

INSTRUMENTOS EXTRANJEROS

TÍTULOS VALORES

Títulos Valores (1)(2)	Tipo	Aforo	Entidad Depositaria	Moneda	Monto Mínimo
Bonos	Treasury (hasta 3 años)	95%	Caja de Valores	USD	USD 10.000
	Treasury (Entre 3 años y 10 años)	90%			

(1) En todos los casos la aceptación de Títulos Valores estará sujeta a consulta previa a Argentina Clearing y Registro.

(2) Retenciones de impuestos de Centrales Depositarias internacionales: En caso de querer solicitar la devolución de retenciones de impuestos practicadas por Caja de Valores sobre títulos estadounidenses, deberán enviar a tesoreria@matbarofex.com.ar y a atencionalcliente@matbarofex.com.ar el Formulario W8 por cada Beneficiario Final (este deberá ser firmado por el comitente). El mismo debe ser presentado en tiempo y forma, conforme a los comunicados de Caja de Valores, y se debe enviar uno por evento corporativo del que se quiera participar. El costo será trasladado al ALyC y es el que detalla Caja de Valores en los comunicados respectivos.
En caso de que el tenedor de los títulos desee que dicho trámite sea gestionado directamente por el agente ante Caja de Valores, podrán alternativamente extraer dichos activos de los fideicomisos en garantía, en una fecha previa a la de la retención.
Señalamos que es de exclusiva responsabilidad de los tenedores de los títulos (ya sea el mismo agente o sus comitentes) tomar o no acción al respecto, razón por la cual lo declarado en este apartado no podrá interpretarse como recomendaciones o sugerencias de nuestra parte.

FONDOS

	Tipo	Aforo	Entidad Financiera	Nombre	Moneda	ISIN	Monto Mínimo
Fondos (1)	Money Market	100%	BOFA	FCI JP Morgan USD Treasury CNAV (3)	USD	LU1873132440	USD 500.000
	Money Market	100%	BOFA	JP Morgan US Dollar Liquidity Fund Institutional (3)	USD	LU0103813712	USD 500.000

(1) En todos los casos la aceptación de Fondos estará sujeta a consulta previa a Argentina Clearing y Registro.
(2) Las suscripciones/rescates de estos fondos se realizarán en múltiplos de U$S 50.000.-
(3) Las suscripciones/rescates de estos fondos se realizarán en múltiplos de U$S 500.000.-